

Prof. Dr. J. Woerner  
LS IV Stochastik

**Seminar Stochastik**  
**SS 24**

Extremwerttheorie beschäftigt sich mit der Modellierung von extremen bzw. seltenen Ereignissen und deren Analyse, wobei eine wesentliche Rolle das asymptotische Verhalten von Maxima von Zufallsvariablen spielt. Klassische Anwendungen sind sowohl im Finanz- und Versicherungsbereich als auch bei Wetter-Phänomenen wie z.B. Hochwasser und Stürme.

Aufbauend auf die Vorlesung Stochastik II werden wir ausgewählte Themenbereiche der Extremwerttheorie genauer erarbeiten.

**Literatur:**

L. de Haan, A. Ferreira, Extreme Value Theory: An Introduction, Springer, 2006.

**Vorbesprechung:** n.V. im März